

INFORME ANUAL DEL EJERCICIO ECONÓMICO 2022

ELABORADO POR EL COMITÉ DE VIGILANCIA

DEL

FONDO DE INVERSIÓN FACTOR SURA

LIMA, 15 de marzo de 2023

INFORME ANUAL DE LA GESTIÓN DEL COMITÉ DE VIGILANCIA DEL FONDO DE INVERSIÓN FACTOR SURA

DESCRIPCIÓN DE LAS FUNCIONES DEL COMITÉ

El presente informe tiene por finalidad detallar la gestión que ha llevado a cabo el Comité de Vigilancia (el "Comité") durante el ejercicio económico 2022. A tales efectos, debemos partir por determinar cuál es la función del Comité respecto del FONDO DE INVERSIÓN FACTOR SURA (el "Fondo").

Al respecto, el artículo 25 del Reglamento de Participación del Fondo (el "Reglamento") se describe las principales funciones del Comité, las cuales se transcriben a continuación:

"El Comité de Vigilancia tendrá las siguientes atribuciones:

- a) Vigilar que la Sociedad Administradora cumplan, respecto del Fondo, con lo dispuesto en la Ley de Fondos de Inversión, el presente Reglamento y los términos de colocación;
- b) Convocar a Asamblea General para dar cuenta de su gestión, cuando lo considere necesario;
- c) Convocar a Asamblea General para someter a aprobación la transferencia del Fondo o su liquidación, o cuando lo considere que ello es necesario para proteger los intereses del Fondo cuando se lo soliciten titulares del veinticinco por ciento (25%) del total de las Cuotas suscritas con derecho a voto, exceptuando a las Personas Relacionadas con la Sociedad Administradora que sean titulares de Cuotas.
- d) Participar con voz, pero sin voto en la Asamblea General o Asamblea Especial;
- e) Revisar que el órgano o persona responsable de verificar el cumplimiento de las normas internas de conducta, cumpla con sus funciones;
- f) Contratar los servicios necesarios para el cumplimiento de sus funciones, siempre que medie autorización de la Asamblea;
- g) Resolver los conflictos de interés que se presenten respecto de las Inversiones del Fondo y demás asuntos que sean sometidos a su consideración;
- h) Revisar los gastos y comisiones cobrados al Fondo;
- i) Someter los estados financieros auditados anuales del Fondo para la aprobación de la Asamblea General;
- j) Acceder a la siguiente información de carácter trimestral: (i) evolución del valor cuota; y, (ii) Estados Financieros del Fondo con explicación de las principales cuentas del Fondo;
- k) Proponer a la Sociedad de Auditoría del Fondo para su elección en Asamblea General;
- l) Convocar a Asamblea General en los casos señalados en el presente Reglamento;
- m) Aprobar la contratación de Personas Relacionadas a la Sociedad Administradora para la presentación de servicios al Fondo que sean pagados con cargo a los recursos del Fondo;

- n) Verificar que el Fondo únicamente se haga cargo de los gastos establecidos en el Reglamento, y;
- o) Las demás que se establezcan en el presente Reglamento o le sean delegadas por la Asamblea General.

GESTIÓN DEL COMITÉ DURANTE EL EJERCICIO ECONÓMICO 2022

Habiéndose detallado las actividades que el Comité desarrolla dentro del Fondo y entendiendo su ámbito de actuación, corresponde ahora analizar la actuación del Comité a lo largo del ejercicio económico 2022.

1. Actividades realizadas:

1.1 El día 11 de julio de 2022 se realizó de forma virtual una sesión del Comité. Dentro de esta sesión se revisaron los siguientes puntos:

Elección del presidente del Comité de Vigilancia:

- De acuerdo con el Reglamento del Fondo los miembros del Comité designaron como presidente a la señora Zoila Patricia Mascaró Díaz y como vicepresidente al señor George Ode Segebre.

Información general:

- Se revisó el número cuotas suscritas, valor cuota, patrimonio neto y conformación de comités vigentes a 31 de marzo de 2022.

Evolución del Fondo desde inicio de operaciones:

- Se revisaron los estados financieros no auditados del Fondo al cierre del primer trimestre de 2022. Las principales cifras en soles peruanos son: Activo PEN 69,704,255, Pasivo PEN 363,175, Patrimonio PEN 69,341,080, Utilidad neta PEN 831,272.
- Se revisó la evolución del valor cuota del Fondo desde el inicio de operaciones, junto con el incremento en el AUM del Fondo. Durante el primer trimestre se realizaron llamados a capital por PEN 6.7MM.
- Se revisó el cronograma de distribución de resultados y las ventanas de liquidez del Fondo. Durante el cuarto trimestre se distribuyó intereses acumulados por un monto de PEN 807,337.

Estado del portafolio:

- A corte de diciembre de 2022 se informó que el portafolio de inversión del Fondo se encuentra diversificado por empresa, plazo de cartera y moneda.

- De igual forma a la fecha se tiene utilizada la línea por PEN 59.7 MM, el portafolio presenta un rating ponderado crediticio de BB+ internacional. Los pagos a la deuda se han cumplido y no se presentan indicadores o alarmas de deterioro de cartera por parte de las empresas pagadoras.

Otros temas:

- De acuerdo con las facultades otorgadas por la Asamblea de Participes del 02 de mayo, se aprobó designar como auditores externos del Fondo para el periodo 2022 a la firma “Caipo & Asociados Sociedad Civil de Responsabilidad Limitada”, representantes de KPMG
- A la fecha no se identifican potenciales conflictos de intereses o situaciones que dificulten la gestión y/o administración del Fondo.

1.2 Mediante sesión virtual de Comité de Vigilancia de fecha 26 de setiembre de 2022 se revisaron los resultados del segundo trimestre del año 2022, respecto a:

Información general:

- Se revisó el número cuotas suscritas, valor cuota, patrimonio neto y conformación de comités vigentes a 30 de junio y 31 de agosto 2022.

Evolución del Fondo desde inicio de operaciones:

- Se revisaron los estados financieros no auditados del Fondo al cierre del segundo trimestre de 2022. Las principales cifras en soles peruanos son: Activo PEN 77,984,020, Pasivo PEN 365,488, Patrimonio PEN 77,618,531, Utilidad neta PEN 2,204,046.
- Se revisó la evolución del valor cuota del Fondo desde el inicio de operaciones, junto con el incremento en el AUM del Fondo. Durante el segundo trimestre se realizaron llamados a capital por PEN 8.0 MM.
- Se revisó el cronograma de distribución de resultados y las ventanas de liquidez del Fondo. Durante el cuarto trimestre se distribuyó intereses acumulados por un monto de PEN 1,151,192.

Estado del portafolio:

- A corte de junio de 2022 se informó que el portafolio de inversión del Fondo se encuentra diversificado por empresa, plazo de cartera y moneda.
- De igual forma a la fecha se tiene utilizada la línea por PEN 56.4 MM, el portafolio presenta un rating ponderado crediticio de BB+ internacional. Los pagos a la deuda se han cumplido y no se presentan indicadores o alarmas de deterioro de cartera por parte de las empresas pagadoras.

Otros temas:

- A la fecha no se identifican potenciales conflictos de intereses o situaciones que dificulten la gestión o administración del Fondo.

1.3 Mediante sesión virtual de Comité de Vigilancia de fecha 29 de noviembre de 2022 se revisaron los resultados del tercer trimestre del año 2022, respecto a:

Información general:

- Se revisó el número cuotas suscritas, valor cuota, patrimonio neto y conformación de comités vigentes a 30 de setiembre y 31 de octubre 2022. De manera particular se comenta la salida de Armando Vidal y la entrada de Luis Caballero al Comité de inversiones del Fondo.

Evolución del Fondo desde inicio de operaciones:

- Se revisaron los estados financieros no auditados del Fondo al cierre del tercer trimestre de 2022. Las principales cifras en soles peruanos son: Activo PEN 75,164,667, Pasivo PEN 266,362, Patrimonio PEN 74,898,305, Utilidad neta PEN 3,509,517.
- Se revisó la evolución del valor cuota del Fondo desde el inicio de operaciones, junto con el incremento en el AUM del Fondo. Durante el tercer trimestre se realizaron llamados a capital por PEN 1.2 MM.
- Se revisó el cronograma de distribución de resultados y las ventanas de liquidez del Fondo. Durante el cuarto trimestre se distribuyó intereses acumulados por un monto de PEN 1,248,640.

Estado del portafolio:

- A corte de setiembre de 2022 se informó que el portafolio de inversión del Fondo se encuentra diversificado por empresa, plazo de cartera y moneda.
- De igual forma a la fecha se tiene utilizada la línea por PEN 56.4 MM, el portafolio presenta un rating ponderado crediticio de BB+ internacional. Los pagos a la deuda se han cumplido y no se presentan indicadores o alarmas de deterioro de cartera por parte de las empresas pagadoras.

Otros temas:

- A la fecha no se identifican potenciales conflictos de intereses o situaciones que dificulten la gestión y/o administración del Fondo.

1.4 Mediante sesión virtual de Comité de Vigilancia de fecha 27 de febrero de 2023 se revisaron los resultados del cuarto trimestre del año 2022, respecto a:

Información general:

- Se revisó el número cuotas suscritas, valor cuota, patrimonio neto y conformación de comités vigentes a 31 de diciembre 2022 y 31 de enero 2023.

Evolución del Fondo desde inicio de operaciones:

- Se revisaron los estados financieros no auditados del Fondo al cierre del cuarto trimestre de 2022. Las principales cifras en soles peruanos son: Activo PEN 74,980,696, Pasivo PEN 152,201, Patrimonio PEN 74,828,496, Utilidad neta PEN 4,367,374.
- Se revisó la evolución del valor cuota del Fondo desde el inicio de operaciones, junto con el incremento en el AUM del Fondo. Durante el cuarto trimestre no se realizaron llamados a capital adicionales, con lo anterior durante el 2022 el Fondo acumuló llamados de capital por aproximadamente PEN 14 MM.
- Se revisó el cronograma de distribución de resultados y las ventanas de liquidez del Fondo. Durante el cuarto trimestre se distribuyó intereses acumulados por un monto de PEN 1,123,397.

Estado del portafolio:

- A corte de diciembre de 2022 se informó que el portafolio de inversión del Fondo se encuentra diversificado por empresa, plazo de cartera y moneda.
- De igual forma a la fecha se tiene utilizada la línea por PEN 42.4 MM, el portafolio presenta un rating ponderado crediticio de BB+ internacional. Los pagos a la deuda se han cumplido y no se presentan indicadores o alarmas de deterioro de cartera por parte de las empresas pagadoras.

Otros temas:

- A la fecha no se identifican potenciales conflictos de intereses o situaciones que dificulten la gestión y/o administración del Fondo.

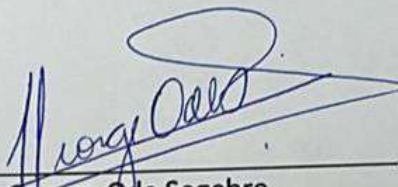
COMENTARIOS FINALES A LA GESTIÓN DEL EJERCICIO ECONÓMICO 2022

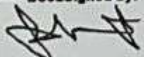
Debemos recalcar que el Comité de Vigilancia tuvo una actuación activa en el 2022, mediante las sesiones del Comité, actuando en todo momento con diligencia y buena fe.

DocuSigned by:

0392A2EC183D424...

Zoila Patricia Mascaró Díaz
Presidente


George Ode Segebre
Vicepresidente

DocuSigned by:

F8E045FFB47C470...

Cirilo Roberto Atencio Mucha
Miembro Titular